

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成27年10月30日

【発行者名】 JPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッド
(JPMAM Japan Cayman Fund Limited)【代表者の役職氏名】 取締役 サイモン・エフ・ウォールス
(Simon F. Walls, Director)【本店の所在の場所】 ケイマン諸島、KY1 - 1104、グランド・ケイマン、
ウグランド・ハウス、私書箱309、
メイプルズ・コーポレート・サービス・リミテッド気付
(C/O Maples Corporate Services Limited,
PO Box 309, Ugland House,
Grand Cayman KY1-1104, Cayman Islands)【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
同 廣 本 文 晴【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
同 廣 本 文 晴【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】

G I Mケイマン・トラスト I -
日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド
(GIM Cayman Trust I -
Nikko Global Financial Sector Bond Fund) (注)(注) 平成27年7月31日付で、ファンドの名称が「JPMオルガン・ケイマン・トラスト I - 日興」
JP Morganグローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(JPMorgan Cayman Trust I - Nikko JPM
Global Financial Sector Bond Fund)」から「G I Mケイマン・トラスト I - 日興グロー
バル金融機関ハイブリッド証券ファンド(GIM Cayman Trust I - Nikko Global Financial
Sector Bond Fund)」に変更されました。

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】

クラスA 受益証券：5,000億円を上限とします。

クラスB 受益証券：5,000億円を上限とします。

(注) クラスA 受益証券およびクラスB 受益証券は円建てとします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成27年7月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また原届出書に訂正すべき事項がありますのでこれらを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

（1）半期報告書の提出に伴う訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書			半期報告書		訂正の方法
第二部 第1 1	ファンド情報 ファンドの状況 ファンドの性格	(3) ファンドの仕組み 管理会社の概況 () 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
5	運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
		(3) 運用実績		(2) 運用実績	更新 / 追加
		(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 1	ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第1 1	特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2	事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。（5 管理会社の経理の概況は、訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

JPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッド（以下「管理会社」といいます。）が管理するGIMケイマン・トラスト I（以下「トラスト」といいます。）のシリーズ・トラストである日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（以下「ファンド」という。）の運用状況は、以下のとおりです。

（１）投資状況

（資産別および地域別の投資状況）

本表は、ファンドのクラスA受益証券およびクラスB受益証券の資産を合計して表示したものです。

（平成27年8月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
債券	米国	60,853,954,741	46.32
	イギリス	16,558,930,948	12.60
	スイス	10,314,449,794	7.85
	フランス	6,897,464,464	5.25
	ベルギー	5,362,973,973	4.08
	スペイン	4,957,009,463	3.77
	スウェーデン	4,699,670,813	3.58
	デンマーク	2,876,859,603	2.19
	アイルランド	2,370,579,001	1.80
	オランダ	1,462,424,210	1.11
中期債券	スウェーデン	2,344,855,642	1.78
	イギリス	2,207,823,004	1.68
小計		120,906,995,656	92.02
現金・預金・その他資産（負債控除後）		10,483,905,334	7.98
合計（純資産総額）		131,390,900,990	100.00

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。以下同じです。

（注２）本書の中で金額および比率を表示する場合には、四捨五入しております。したがって、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合には四捨五入しております。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もあります。

(2) 運用実績

純資産の推移

平成27年8月末日までの1年間における各月末の純資産の推移は、以下のとおりです。

(クラスA受益証券)

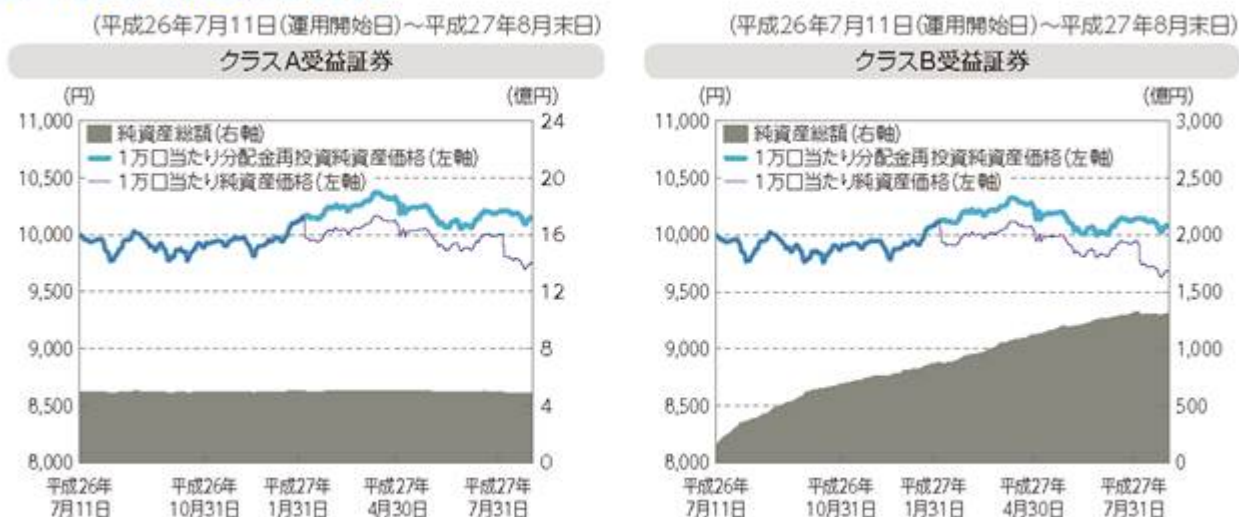
	純資産総額（円）	1口当たり純資産価格（円）
平成26年9月末日	488,706,302	0.9774
10月末日	494,610,391	0.9892
11月末日	498,344,381	0.9967
12月末日	496,335,382	0.9927
平成27年1月末日	506,252,891	1.0125
2月末日	501,966,422	1.0039
3月末日	503,828,918	1.0076
4月末日	504,417,684	1.0088
5月末日	502,724,772	1.0054
6月末日	492,739,608	0.9855
7月末日	499,911,989	0.9998
8月末日	487,598,909	0.9752

(クラスB受益証券)

	純資産総額（円）	1口当たり純資産価格（円）
平成26年9月末日	61,604,541,858	0.9761
10月末日	69,104,351,052	0.9874
11月末日	74,710,889,413	0.9944
12月末日	80,761,869,982	0.9898
平成27年1月末日	87,340,409,589	1.0091
2月末日	93,370,191,493	1.0000
3月末日	104,483,954,506	1.0032
4月末日	112,742,011,527	1.0039
5月末日	119,798,236,511	1.0000
6月末日	125,420,974,211	0.9796
7月末日	131,762,381,170	0.9934
8月末日	130,903,302,081	0.9684

< 参考情報 >

純資産価格・純資産の推移



(注1) 分配金再投資純資産価格は、税引前分配金を各クラスに再投資したとみなして算出したものです。

(注2) 純資産価格および分配金再投資純資産価格は、1万口当たり、管理報酬等控除後の価格です。

分配の推移

計算期間	1口当たりの支払分配金（円）	
	クラスA 受益証券	クラスB 受益証券
平成26年9月1日～平成27年8月末日	0.0400	0.0400

< 参考情報 >

分配の推移

	1万口当たりの支払分配金（円）（税引前）	
	クラスA 受益証券	クラスB 受益証券
第1会計年度 (平成26年7月11日～平成27年1月末日)	—	—
平成27年2月	200	200
平成27年8月	200	200
設定来累計	400	400

(注) 初回の分配基準日は、平成27年2月5日でした。

収益率の推移

計算期間	収益率（注）	
	クラスA 受益証券	クラスB 受益証券
平成26年9月1日～平成27年8月末日	1.40%	0.80%

(注) 収益率（%）＝ 100 × (a - b) / b

a = 計算期間末の1口当たり純資産価格 + 当該期間の分配金の合計

b = 当該計算期間の直前の日の1口当たり純資産価格（分配前の額）

< 参考情報 >

年間収益率の推移



(注1) 収益率(%)=100×(a-b)÷b

a=当該各暦年末日の1口当たり純資産価格(当該各暦年の分配金の合計額を加えた額)

b=当該各暦年の直前の暦年の最終評価日における1口当たり純資産価格(分配後の額)(平成26年については、1円)

(注2) 平成26年については平成26年7月11日(運用開始日)から同年末日まで、平成27年については平成27年1月1日から同年8月末日までの収益率となります。

2 販売及び買戻しの実績

下記計算期間中の販売および買戻しの実績ならびに下記計算期間末日現在の発行済口数は、以下のとおりです。

(クラスA 受益証券)

計算期間	販売口数	買戻し口数	発行済口数
平成26年9月1日～平成27年8月末日	0 (0)	0 (0)	500,010,000 (500,010,000)

(注) () 内の数字は、本邦内における販売口数、買戻し口数および発行済口数です。以下同じです。

(クラスB 受益証券)

計算期間	販売口数	買戻し口数	発行済口数
平成26年9月1日～平成27年8月末日	91,671,430,000 (91,671,430,000)	4,130,180,000 (4,130,180,000)	135,180,130,000 (135,180,130,000)

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. ファンドの日本文の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文（英文）の中間財務書類を日本語に翻訳したものである。ファンドの日本文の中間財務書類は「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定に準拠して作成されている。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c. ファンドの原文（英文）の中間財務書類は、日本円で表示されている。

(1) 資産及び負債の状況

GIMケイマン・トラスト I

純資産計算書

2015年7月31日現在

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

(日本円で表示)

	注記	日本円
資産		
投資有価証券の時価評価額 (取得原価 113,487,401,665円)	2.2	123,287,820,164
銀行預金		9,240,603,101
債券に係る未収利息	2.6	1,170,087,977
先渡外国為替契約に係る未実現評価益	2.5, 13	647,985,663
設立費用	2.4	19,624,936
その他の資産		490,711
資産合計		134,366,612,552
負債		
先渡外国為替契約に係る未実現評価損	2.5, 13	1,882,423,259
未払管理報酬および未払販売管理報酬	4	113,432,713
未払投資運用報酬	6	65,071,583
未払販売報酬	9	10,988,068
未払代行協会員報酬	8	10,841,848
未払管理事務代行報酬	5	7,531,616
未払保管報酬	7	5,360,862
未払印刷および公告費		3,412,689
未払設立費用	2.4	2,258,317
未払専門家費用		1,500,423
未払弁護士報酬		1,498,015
負債合計		2,104,319,393
純資産総額		132,262,293,159
純資産総額		
クラスA 受益証券		499,911,989
クラスB 受益証券		131,762,381,170
発行済受益証券口数		
クラスA 受益証券		500,010,000
クラスB 受益証券		132,637,080,000
1口当たり純資産価格		
クラスA 受益証券		0.9998
クラスB 受益証券		0.9934

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

GIMケイマン・トラスト I

運用計算書および純資産変動計算書
2015年2月1日から2015年7月31日までの期間

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

（日本円で表示）

	注記	日本円
収益		
債券に係る受取利息	2.6	2,499,855,293
受取配当金	2.7	217,395,053
収益合計		2,717,250,346
費用		
管理報酬および販売管理報酬	4	577,513,288
投資運用報酬	6	331,706,896
販売報酬	9	56,107,094
代行協会員報酬	8	55,238,562
管理事務代行報酬	5	38,410,855
保管報酬	7	27,351,173
設立費用	2.4	5,040,984
保護預かり費用		4,284,657
専門家費用		1,505,830
印刷および公告費		2,533,602
弁護士報酬		1,560,629
受託報酬	3	610,543
取引費用		59,571
その他の費用		5,659
費用合計		1,101,929,343
投資純利益		1,615,321,003

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

GIMケイマン・トラスト I

運用計算書および純資産変動計算書（つづき）
2015年2月1日から2015年7月31日までの期間

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

（日本円で表示）

	注記	日本円
投資純利益		1,615,321,003
以下に係る実現純損益：		
投資有価証券	2.3	346,275,301
外国為替	2.3	33,281,968
先渡外国為替契約	2.5	(1,513,021,516)
当期実現純利益		481,856,756
以下にかかる未実現評価損益の純変動：		
投資有価証券	2.3	3,961,930,180
外国為替		429,478
先渡外国為替契約	2.5	(4,228,058,904)
運用による純資産の純増加		216,157,510
資本の変動		
受益証券の発行		47,640,089,332
受益証券の買戻し		(1,688,446,363)
資本の変動、純額		45,951,642,969
支払分配金	12	(1,752,169,800)
期首現在純資産額		87,846,662,480
期末現在純資産額		132,262,293,159

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

GIMケイマン・トラスト I

統計情報

日興グローバル金融機関
ハイブリッド証券ファンド

クラス A 受益証券

クラス B 受益証券

期末現在発行済受益証券口数：

2015年 1 月31日	500,010,000	86,553,100,000
発行口数	-	47,784,730,000
買戻口数	-	(1,700,750,000)
2015年 7 月31日	500,010,000	132,637,080,000

期末現在純資産総額：

日本円

日本円

2015年 1 月31日	506,252,891	87,340,409,589
2015年 7 月31日	499,911,989	131,762,381,170

期末現在 1 口当たり純資産価格：

日本円

日本円

2015年 1 月31日	1.0125	1.0091
2015年 7 月31日	0.9998	0.9934

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

[次へ](#)

GIMケイマン・トラスト I

財務書類に対する注記

(2015年7月31日現在)

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

注記1. 活動および目的

GIMケイマン・トラスト I（以下「トラスト」という。）は、受託会社と管理会社との間で締結された2014年5月12日付信託証書により設定されたオープン・エンド型アンブレラ・ユニット・トラストである。

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（以下「ファンド」という。）は、2014年7月11日に運用を開始したトラストの個別のシリーズ・トラストであり、インタートラスト・エス・ピー・ヴィー（ケイマン）リミテッド（以下「受託会社」という。）およびJPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッド（以下「管理会社」という。）との間で2014年5月12日付で締結された信託証書および補遺信託証書に従って構成されている。ファンドは、日本の金融商品取引法（以下「FIEL」という。）に従って財務省関東財務局（以下「KLFB」という。）に届出がなされ、ファンドに関する通知は、投信法に従って金融庁に提出される。

本財務書類は、ファンドについてのみ言及している。

受益証券クラス

クラスA受益証券およびクラスB受益証券が発行可能である。

クラスA受益証券の申込みに関し、申込手数料がファンドに関して間接持分を有し、またはこれを申し込んでいる者により、販売会社に支払われ、保持されることがある。

クラスB受益証券の買戻しは、当該受益証券が買い戻されるまでの保有期間に応じた買戻手数料の対象となる場合がある。

投資目的および方針

ファンドの投資目的は、銀行、保険会社およびその他の金融会社等の金融機関により発行される、債券およびハイブリッド証券（以下「金融債券」という。）への投資を通じて、利息収益等のインカム・ゲインおよび中長期的な元本成長による競争力のある投資収益を獲得することである。

注記2．重要な会計方針

2.1 - 財務書類の表示

本財務書類は、投資信託に適用される、ルクセンブルグで一般的に認められている会計原則に従い作成されている。

ファンドの基準通貨は、日本円である。ファンドの投資は、大部分が日本円以外の通貨建てになると予想される。

2.2 - 有価証券およびその他の資産への投資の評価

- (a) 証券取引所もしくは店頭市場に上場され、または証券取引所もしくは店頭市場で値付けされている株式等のエクイティ性商品は、関連する評価日における直近の入手可能な始値または終値か、または当該日に取引が行われなかった場合は関係評価日時点で入手可能な最終買呼値（管理事務代行会社が保有規模を考慮した上でその裁量により適切と判断する方法により調整される。）で評価され、特定のエクイティ性商品につき複数の取引所または店頭市場で価格が入手可能である場合、当該エクイティ性商品の価格は、当該エクイティ性商品の主要市場である取引所もしくは店頭市場または当該エクイティ性商品に値を付けるにあたり最も公正な基準を提供すると管理事務代行会社が判断する取引所もしくは店頭市場（場合による。）において入手可能な直近の始値または終値となる。
- (b) 証券取引所もしくは店頭市場に上場され、または証券取引所もしくは店頭市場で値付けされているものの、かかる証券取引所もしくは店頭市場で定期的に取り引されていないか、またはかかる証券取引所もしくは店頭市場に関し上記の価格が入手可能でないエクイティ性商品は、管理事務代行会社または管理事務代行会社によりかかる目的で承認される適格な者により、原価、当該証券の直近の取引価格、保有規模（発行済当該エクイティ性商品の総額を考慮する。）および評価へのプラスまたはマイナスの調整を検討する上で関連性があると管理事務代行会社がその裁量により判断するその他の要因を考慮した上で慎重かつ誠実に見積もられる推定実現価格で評価される。
- (c) 証券取引所もしくは店頭市場もしくはその他の場所に上場され、または証券取引所もしくは店頭市場もしくはその他の場所で値付けされている債券または負債性証券は、管理事務代行会社が選任する信用ある評価情報提供源または評価情報提供会社により提供される、関連する評価日における直近の入手可能な買呼値で評価される。
- (d) 証券取引所もしくは店頭市場に上場されておらず、または証券取引所もしくは店頭市場で値付けされていない証券は、管理事務代行会社もしくは管理事務代行会社によりかかる目的で承認されるその他の適格な者により必要と判断される時点に、年1回以上、慎重かつ誠実に見積もられる推定実現価格で評価される。
- (e) 取引所または市場で取り扱われ、または取引されるデリバティブ商品は、該当する取引所または市場における当該決済価格で評価される。かかる価格が入手可能でない場合、当該商品の価格は、管理事務代行会社によりかかる目的で承認される適格な者により慎重かつ誠実に見積もられる推定実現価格となる。取引所または市場で取り扱われておらず、または取引されていないデリバティブ商品は、取引相手方から得られる評価額に基づき評価される。
- (f) 預金は、預入金額に経過利息を加算した価格で評価される。

(g) 残存期間が60暦日以下である短期投資は、償却価格でまたは購入日における市場価格と額面金額との差額を償却することにより評価される。

管理事務代行会社は、受託会社の最終権限の下で、上記の評価原則が不明瞭または公平でない状況においてかかる評価原則を適用する方法を決定する。受託会社は、複数の方法が適用されるか、または法律に適う状況においてかかる評価原則を適用する方法を決定する。

2.3 外貨換算

日本円以外の通貨で表示される資産および負債は、当期末における為替レートで日本円に換算される。外貨で表示される取引は、取引日現在の実勢為替レートにより日本円に換算される。

当期の損益を決定するにあたり、外国為替換算に係る未実現および実現利益または損失は、運用計算書および純資産変動計算書において認識されている。

組入有価証券の時価評価額に起因する未実現為替差損益は、投資有価証券に係る未実現評価損益の純変動に含まれる。その他の為替差損益は、運用計算書および純資産変動計算書に直接計上される。

2.4 設立費用

設立費は、定額法で3年にわたり償却される。

2.5 先渡外国為替契約

先渡外国為替契約は、満期日までの残存期間について純資産計算書の日付現在適用される先渡レートで評価される。

先渡外国為替契約から生じる損益は、運用計算書および純資産変動計算書において認識される。

2.6 受取利息

受取利息は、日次ベースで発生し、プレミアムの償却およびディスカウントの増加（該当する場合）を含む。預金利息は、発生主義で認識される。

2.7 受取配当金

配当金は、当該有価証券が「配当落ち」として初めて記載された日付に収益に計上される。受取配当金は、配当落ち日に発生する。源泉徴収税控除後に当該収益が表示され、税金の還付申請がある場合には調整される。

2.8 投資に係る実現損益

投資取引は、取引日（売買注文が実行された日）に会計処理される。

2.9 支払分配金

ファンドは、クラス毎にクラスに係る分配を宣言する予定である。ファンドは、原則として、分配基準日の時点の受益者に対して年2回分配を宣言する予定である。2015年2月から年2回分配が宣言される予定である。

分配は、インカム・ゲイン、キャピタル・ゲインおよび元本から行うことができる。関連するクラスに帰属する業務を行う通常の過程において、支払期限が到来しているかまたは支払うことが明らかな債務、負債または義務を履行するために十分な資産が当該クラスにある場合に、分配を行うことができる。

注記3．受託報酬

受託会社は、ファンドの資産から、会計年度ベースの各四半期毎に後払いされる年額10,000米ドルの受託報酬を、追加的に費やした時間に対する報酬、立替金、立替費用および設立費用を加算して、当該四半期の最終営業日から30営業日以内に受領する権利を有する。

注記4．管理報酬および販売管理報酬

管理会社は、ファンドの資産から、ファンド純資産総額の年率0.10%の管理報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日に計算され、四半期毎に後払いされる。

管理会社はまた、ファンドの資産から、クラスB受益証券に帰属する純資産総額のうち年率0.95%の販売管理報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日に計算され、四半期毎に後払いされる。

注記5．管理事務代行報酬

管理事務代行会社は、ファンドの資産から、（ ）ファンド純資産総額の合計の500億円以下の部分について、ファンドの純資産総額の年率0.07%の報酬、および（ ）ファンド純資産総額の合計の500億円を超える部分について、ファンドの純資産総額の年率0.069%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日毎に計算され、四半期毎に後払いされる。ただし、管理事務代行会社は、年間最低報酬12,500ユーロを受領する権利を有する。

注記6．投資運用報酬

投資運用会社は、ファンドの資産から、ファンド純資産総額の年率0.60%の投資運用報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日毎に計算され、四半期毎に後払いされる。

注記7．保管報酬

保管会社は、ファンドの資産から、（ ）ファンド純資産総額の合計の500億円以下の部分について、ファンドの純資産総額の年率0.05%の報酬、および（ ）ファンド純資産総額の合計の500億円を超える部分について、ファンドの純資産総額の年率0.049%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日毎に計算され、四半期毎に後払いされる。ただし、保管会社は、年間最低報酬3,000ユーロを受領する権利を有する。

注記8．代行協会員報酬

代行協会員は、ファンドの資産から、ファンドの純資産総額のうち年率0.10%の代行協会員報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日毎に計算され、四半期毎に後払いされる。

注記9．販売報酬

販売会社は、クラスA受益証券に帰属するファンドの資産から、年率0.45%の販売報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日毎に計算され、四半期毎に後払いされる。

販売会社は、クラスB受益証券に帰属するファンドの資産から、年率0.10%の販売報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、日々発生し、各計算日毎に計算され、四半期毎に後払いされる。

注記10．税金

10.1 - ケイマン諸島

現行のケイマン諸島における税法に基づき、ファンドにより支払われる税金はない。従って、所得税に対する引当金は財務書類に計上されていない。

10.2 - その他の国々

ファンドは、その他の国々において稼得される特定の所得に対する源泉税またはその他の税金を課されることがある。

購入予定者は、各国の管轄法に基づき受益証券を購入、保有および買戻す際、予想される課税およびその他の影響を決定づけるその市民権、居住地および住居を所有する国において、法律アドバイザーまたは税務アドバイザーに相談することが望ましい。

注記11．為替レート

2015年7月31日現在、日本円に対して使用された為替レートは以下の通りである。

通貨	為替レート
ユーロ	135.8166
英ポンド	193.3902
米ドル	124.2149

注記12．支払分配金

2015年7月31日に終了した期間中、ファンドが行った分配は以下の通りである。

受益証券10,000口当たり 支払分配金	基準日	分配落ち日	支払日
クラスA 受益証券			
200円	2015年2月5日	2015年2月6日	2015年2月12日
クラスB 受益証券			
200円	2015年2月5日	2015年2月6日	2015年2月12日

注記13．先渡外国為替契約

2015年7月31日現在、ファンドの通貨エクスポージャーの管理に連動した以下の先渡外国為替契約が未決済であった。

通貨	買い	通貨	売り	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					日本円
英ポンド	367,406.73	日本円	70,770,766	2015年8月5日	276,096
英ポンド	63,665,592.13	米ドル	99,075,694.15	2015年8月5日	5,219,101
米ドル	3,674,208.52	日本円	450,233,837	2015年8月5日	6,134,074
米ドル	613,535.60	日本円	75,113,813	2015年8月5日	1,092,520
米ドル	893,495.91	日本円	108,445,474	2015年8月5日	2,534,308
米ドル	575,058.59	日本円	69,821,825	2015年8月5日	1,605,337
米ドル	330,453,189.40	日本円	41,061,155,000	2015年8月5日	(16,061,580)
米ドル	330,479,158.01	日本円	41,061,771,000	2015年8月5日	(13,452,058)
米ドル	330,399,654.00	日本円	41,061,771,640	2015年8月5日	(23,327,772)
ユーロ	1,860,899.63	日本円	255,429,688	2015年8月5日	(2,685,302)
ユーロ	1,032,533.93	日本円	138,263,933	2015年8月5日	1,973,160
ユーロ	587,509.07	日本円	78,729,158	2015年8月5日	1,065,376
ユーロ	147,883,270.97	米ドル	161,768,474.93	2015年8月5日	(7,751,144)

通貨	買い	通貨	売り	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					日本円
米ドル	1,381,960.07	日本円	170,978,822	2015年9月3日	623,293
ユーロ	902,684.76	日本円	123,206,630	2015年9月3日	(594,195)
日本円	257,580,342	英ポンド	1,330,875.00	2015年8月5日	223,890
日本円	198,446,625	英ポンド	1,026,223.18	2015年8月5日	1,875
米ドル	96,943,845.94	英ポンド	61,675,900.68	2015年8月5日	114,741,577
日本円	367,268,100	米ドル	3,000,000.00	2015年8月5日	(5,357,385)
日本円	40,035,535,000	米ドル	327,168,427.18	2015年8月5日	(601,563,047)
日本円	40,036,135,000	米ドル	327,159,160.65	2015年8月5日	(599,812,065)
日本円	40,036,134,669	米ドル	327,099,605.15	2015年8月5日	(592,415,097)
日本円	230,275,639	米ドル	1,874,247.25	2015年8月5日	(2,521,791)
日本円	318,061,735	米ドル	2,579,149.40	2015年8月5日	(2,290,531)
日本円	243,564,263	米ドル	1,978,262.43	2015年8月5日	(2,152,736)
日本円	258,217,587	米ドル	2,083,080.26	2015年8月5日	(518,677)
日本円	930,042,750	米ドル	7,500,000.00	2015年8月5日	(1,520,964)
日本円	246,595,241	米ドル	1,984,652.38	2015年8月5日	84,556
日本円	67,494,972	ユーロ	492,663.67	2015年8月5日	582,187
日本円	152,791,321	ユーロ	1,120,249.00	2015年8月5日	640,909
日本円	126,875,508	ユーロ	937,362.00	2015年8月5日	(435,487)
日本円	133,733,159	ユーロ	998,131.56	2015年8月5日	(1,831,459)
日本円	139,614,600	ユーロ	1,020,139.07	2015年8月5日	1,060,957
日本円	342,771,527	ユーロ	2,513,501.86	2015年8月5日	1,391,758
日本円	167,281,962	ユーロ	1,229,324.74	2015年8月5日	317,059
日本円	143,086,134	ユーロ	1,061,262.00	2015年8月5日	(1,052,759)
米ドル	158,859,753.39	ユーロ	141,991,579.70	2015年8月5日	446,663,239
日本円	143,385,231	英ポンド	750,310.00	2015年9月3日	(1,635,462)
米ドル	99,054,684.51	英ポンド	63,665,592.13	2015年9月3日	(5,435,008)
日本円	41,061,155,000	米ドル	330,548,956.66	2015年9月3日	15,902,373
日本円	41,061,771,000	米ドル	330,576,003.44	2015年9月3日	13,159,893
日本円	41,061,771,640	米ドル	330,497,782.88	2015年9月3日	22,873,414
日本円	564,687,190	ユーロ	4,149,182.86	2015年9月3日	1,100,170
日本円	282,731,323	ユーロ	2,071,926.23	2015年9月3日	1,299,829
日本円	282,185,039	ユーロ	2,077,538.25	2015年9月3日	(8,740)
米ドル	161,826,888.82	ユーロ	147,883,270.97	2015年9月3日	7,418,712
先渡外国為替契約に係る未実現純評価損合計					(1,234,437,596)

注記14．後発事象

期末後にファンドが行った分配は以下のとおりである。

受益証券10,000口当たり 支払分配金	基準日	分配落ち日	支払日
クラスA 受益証券			
200円	2015年 8 月 5 日	2015年 8 月 6 日	2015年 8 月11日
クラスB 受益証券			
200円	2015年 8 月 5 日	2015年 8 月 6 日	2015年 8 月11日

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

G I M ケイマン・トラスト I

投資有価証券明細表
2015年7月31日現在

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

（日本円で表示）

数量	銘柄	通貨	取得原価	時価	比率*
. 公認の証券取引所への上場が認められている、または他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券					
A. 債券			日本円	日本円	%
3,000,000	ALLSTATE CORP FRN 15AUG53	米ドル	368,767,325	390,345,254	0.30
6,315,000	AMERICAN EXPRESS CO FRN PERP SER C	米ドル	750,190,771	764,304,504	0.58
3,744,000	AMERICAN INTL GP FRN 15MAR87	米ドル	429,438,773	511,427,036	0.39
9,400,000	BANCO BILBAO VIZC ARG FRN PERP	ユーロ	1,262,793,419	1,289,953,509	0.98
26,600,000	BANCO BILBAO VIZC FRN PERP REGS	ユーロ	3,808,913,865	3,681,218,872	2.78
12,970,000	BANK OF AMERICA CORP FRN PERP SE AA	米ドル	1,568,074,617	1,598,081,770	1.21
5,000,000	BANK OF AMERICA CORP FRN PERP SER K	米ドル	658,456,742	655,606,126	0.50
12,000,000	BANK OF AMERICA CORP FRN PERP SER V	米ドル	1,214,358,609	1,459,589,410	1.10
6,675,000	BANK OF AMERICA CORP FRN PERP SER X	米ドル	706,494,663	826,025,058	0.62
15,100,000	BANK OF AMERICA CORP FRN PERP SER Z	米ドル	1,793,487,496	1,933,602,080	1.46
18,000,000	BANK OF AMERICA FRN PERP SERIES U	米ドル	1,744,758,655	2,107,350,125	1.59
17,012,000	BANK OF IRELAND FRN PERP	ユーロ	2,362,654,412	2,382,415,204	1.80
11,594,000	BANK OF NY MELLON FRN PERP SER D	米ドル	1,131,146,210	1,331,689,804	1.01
17,730,000	BANK OF NY MELLON FRN PERP SER E	米ドル	2,125,384,127	2,191,758,606	1.66
12,600,000	BPCE SA 5.25 16APR29	英ポンド	2,228,812,909	2,568,396,857	1.94
14,335,000	CAPITAL ONE FINANCIAL CO FRN PERP E	米ドル	1,719,912,905	1,780,513,441	1.35
12,000,000	CITIGROUP INC FRN PERP	米ドル	1,257,060,336	1,468,532,881	1.11
8,920,000	CITIGROUP INC FRN PERP	米ドル	1,058,937,775	1,071,443,901	0.81
32,000,000	CITIGROUP INC FRN PERP SER M	米ドル	3,428,335,502	3,886,037,620	2.94
9,505,000	CITIGROUP INC FRN PERP SER N	米ドル	1,053,224,830	1,184,806,542	0.90
7,680,000	CITIGROUP INC FRN PERP SER O	米ドル	932,391,449	958,015,098	0.72
28,300,000	CREDIT AGRICOLE SA FRN PERP	ユーロ	4,042,627,594	3,967,451,007	3.00
17,000,000	CREDIT SUISSE GROUP FRN PERP 144A	米ドル	1,729,229,966	2,054,004,803	1.55
25,000,000	CREDIT SUISSE GROUP FRN PERP 144A	米ドル	2,975,917,160	3,299,644,023	2.49
20,800,000	DANSKE BANK A/S FRN PERP	ユーロ	2,955,259,660	2,882,812,816	2.18
9,000,000	FIFTH THIRD BANCORP FRN PERP	米ドル	870,845,915	1,036,089,962	0.78
7,000,000	GENERAL ELEC CAP CORP FRN PERP C	米ドル	726,813,098	889,928,799	0.67
26,000,000	GOLDMAN SACHS GROUP FRN PERP L	米ドル	2,829,713,080	3,257,296,687	2.46
13,075,000	GOLDMAN SACHS GROUP FRN PERP SER M	米ドル	1,559,652,299	1,605,188,655	1.21
6,000,000	HSBC HOLDINGS PLC FRN PERP	米ドル	706,421,548	746,548,807	0.56
13,180,000	HSBC HOLDINGS PLC FRN PERP	米ドル	1,593,478,727	1,649,136,047	1.25
31,405,000	HSBC HOLDINGS PLC FRN PERP	米ドル	3,433,483,294	3,926,285,532	2.97
39,210,000	KBC GROEP NV FRN PERP	ユーロ	5,280,718,036	5,349,492,969	4.04
33,000,000	LLOYDS BANKING GP FRN PERP	米ドル	3,740,166,260	4,280,639,718	3.24
15,496,000	METLIFE INC FRN PERP	米ドル	1,905,775,468	1,919,001,505	1.45
11,000,000	METLIFE INC FRN 15DEC66	米ドル	1,308,212,875	1,509,831,844	1.14
14,220,000	MORGAN STANLEY FRN PERP	米ドル	1,718,790,768	1,752,699,456	1.33
26,000,000	MORGAN STANLEY FRN PERP	米ドル	2,783,192,597	3,203,330,291	2.42
28,980,000	NATIONWIDE BLDG SOC FRN PERP EMTN	英ポンド	5,141,148,750	5,622,550,769	4.27
6,000,000	PNC FINANCIAL SERV FRN PERP	米ドル	586,693,008	707,331,686	0.53
19,000,000	PRUDENTIAL FINANC INC FRN 15JUN43	米ドル	2,228,559,640	2,445,635,682	1.85
6,000,000	PRUDENTIAL FINANCIAL FRN 15SEP42	米ドル	683,463,355	789,075,013	0.60
3,000,000	PRUDENTIAL FINANCIAL 5.2 15MAR44	米ドル	311,550,539	363,474,967	0.27

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

（*）百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

GIMケイマン・トラスト I

投資有価証券明細表（つづき）
2015年7月31日現在

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

（日本円で表示）

数量	銘柄	通貨	取得原価	時価	比率*
. 公認の証券取引所への上場が認められている、または他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券（つづき）					
A. 債券（つづき）			日本円	日本円	%
10,483,000	RABOBANK NEDERLAND FRN PERP	ユーロ	1,445,329,866	1,471,902,971	1.11
8,908,000	SANTANDER UK GROUP HLDGS FRN PERP	英ポンド	1,714,291,911	1,762,997,214	1.33
9,190,000	STATE STREET CORP FRN PERP SER F	米ドル	1,095,218,807	1,150,438,701	0.87
20,424,000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB FRN PERP	米ドル	2,441,121,169	2,512,381,483	1.90
19,000,000	SWEDBANK AB FRN PERP	米ドル	2,289,141,479	2,352,270,811	1.78
17,000,000	UBS AG STAMFORD CT 7.625 17AUG22	米ドル	2,072,106,507	2,478,873,596	1.87
11,000,000	UBS AG 5.125 15MAY24	米ドル	1,246,166,782	1,384,161,912	1.05
8,497,000	UBS GROUP AG FRN PERP	米ドル	1,046,930,551	1,088,025,124	0.82
3,300,000	WACHOVIA CAP TRUST III FRN PERP	米ドル	326,027,321	405,182,846	0.31
36,000,000	WELLS FARGO AND CO FRN PERP SER S	米ドル	4,149,224,962	4,490,740,489	3.40
10,815,000	WELLS FARGO AND CO FRN PERP SER U	米ドル	1,273,985,664	1,374,913,127	1.04
債券合計			99,814,854,046	107,770,453,010	81.49

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

（*）百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

GIMケイマン・トラスト I

投資有価証券明細表（つづき）
2015年7月31日現在

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

（日本円で表示）

数量	銘柄	通貨	取得原価	時価	比率*
. 公認の証券取引所への上場が認められている、または他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券（つづき）					
B. 優先株式			日本円	日本円	%
100,000	ALLSTATE CORP 6.625 PFD PERP SER E	米ドル	263,530,896	329,666,286	0.25
240,000	BANK OF NY MELLON 5.2 PFD PERP	米ドル	585,660,192	736,345,797	0.56
100,000	BB+T CORP 5.625 PFD PERP SER E	米ドル	242,035,930	307,928,682	0.23
100,000	CAPITAL ONE FIN 6.25 PFD PERP SER C	米ドル	251,150,931	319,729,096	0.24
175,000	CAPITAL ONE FIN 6.7 PFD PERP SER D	米ドル	472,281,380	584,524,162	0.44
194,000	DISCOVER FIN SVS 6.5 PFD PERP SER B	米ドル	498,454,147	631,812,419	0.48
450,000	GOLDMAN SACHS GP FRN PFD PERP SER J	米ドル	1,204,741,275	1,379,530,436	1.04
400,000	GOLDMAN SACHS GP FRN PFD PERP SER K	米ドル	1,202,437,021	1,311,709,113	0.99
300,000	MORGAN STANLEY FRN PFD PERP	米ドル	825,853,770	1,010,053,281	0.76
500,000	MORGAN STANLEY FRN PFD PERP I	米ドル	1,562,389,615	1,589,950,440	1.20
265,000	STATE STREET 5.25 PFD PERP SER C	米ドル	683,917,809	813,706,823	0.62
100,000	STATE STREET 5.90 PFD PERP SER D	米ドル	269,119,898	321,468,104	0.24
225,000	STATE STREET 6 PFD PERP	米ドル	657,460,499	711,564,929	0.54
100,000	US BANCORP 5.15 PFD PERP SER H	米ドル	229,569,256	307,928,682	0.23
100,000	WELLS FARGO AND CO 6 PFD PERP	米ドル	252,515,902	316,375,294	0.24
優先株式合計			9,201,118,521	10,672,293,544	8.06
C. 中期債券			日本円	日本円	%
11,460,000	PRUDENTIAL PLC FRN 19DEC63 EMTN	英ポンド	2,112,292,385	2,399,664,414	1.81
19,546,000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BNK FRN PERP	米ドル	2,359,136,713	2,445,409,196	1.85
中期債券合計			4,471,429,098	4,845,073,610	3.66
公認の証券取引所への上場が認められている、または他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券合計			113,487,401,665	123,287,820,164	93.21
投資有価証券合計			113,487,401,665	123,287,820,164	93.21

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

（*）百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

GIMケイマン・トラスト I

投資有価証券分類表
2015年7月31日現在

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

投資有価証券の国別および業種別分類

国名	業種	比率（％）＊
米国	持株会社の事業	30.31
	保険および年金基金以外のその他金融サービス事業 （他に分類されないもの）	12.73
	生命保険	2.59
	その他の金融仲介機関	1.01
		46.64
イギリス	保険および年金基金以外のその他金融サービス事業 （他に分類されないもの）	9.34
	その他の金融仲介機関	4.27
	持株会社の事業	1.81
		15.42
スイス	持株会社の事業	4.05
	その他の金融仲介機関	2.92
	保険および年金基金以外のその他金融サービス事業 （他に分類されないもの）	0.82
		7.79
スウェーデン	その他の金融仲介機関	5.53
		5.53
フランス	その他の金融仲介機関	4.94
		4.94
ベルギー	持株会社の事業	4.04
		4.04
スペイン	その他の金融仲介機関	3.76
		3.76
デンマーク	その他の金融仲介機関	2.18
		2.18

（＊）百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

GIMケイマン・トラスト I

投資有価証券分類表（つづき） 2015年7月31日現在

日興グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド

投資有価証券の国別および業種別分類

国名	業種	比率（％）＊
アイルランド		
	その他の金融仲介機関	1.80
		1.80
オランダ		
	その他の金融仲介機関	1.11
		1.11
投資有価証券合計		93.21

（＊）百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額

平成27年8月末日現在、管理会社の資本金の額は350万円、払込資本の額は6,000万円であり、全額払込済です。

管理会社の授権株式総数は350万株であり、発行済株式の総数は350万株です。

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社の事業目的は、ケイマン諸島の法律に抵触しない範囲においていかなる制約も受けません。

管理会社は、ファンドの資産の運用および管理、ならびに受益証券の発行・買戻し等の業務を行います。管理会社は、投資運用会社であるJ.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクにファンドの投資運用業務を委託しております。

管理会社は、平成27年8月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っています。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計
ケイマン諸島	契約型投資信託	4	約2,249億円

（３）その他

本書提出前6か月以内において、管理会社に重要な影響を及ぼした事実、または及ぼすことが予想される事実は認知しておりません。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

下線の部分は訂正箇所を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

() 大株主の状況

< 訂正前 >

(平成27年 5 月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率
JPモルガン・アセット・ マネジメント株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング	3,500,000株	100%

< 訂正後 >

(平成27年 8 月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率
JPモルガン・アセット・ マネジメント株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング	3,500,000株	100%

2 投資方針

(3) 運用体制

< 訂正前 >

ファンドは、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門であるJ.P.モルガン・アセット・マネジメントの一員である投資運用会社が運用いたします。

- J.P.モルガン・アセット・マネジメントの運用力・調査力を活用しています。
- グローバルに運用拠点を展開し、各拠点間で緊密な情報交換を行っています。
- グループ全体の債券の運用資産残高は8,134億米ドル(約98兆円)
(平成27年3月末日現在。WMロイター・レート(1米ドル119.93円)で換算)
※キャッシュ(マネーマーケット商品、手形、短期証券等)も含まれます。



(中略)

(注1)運用体制については、J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクを含めたJ.P.モルガン・アセット・マネジメントのものを記載しております。

(注2)上記の運用体制、組織名称等は、平成27年5月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

J.P.モルガン・アセット・マネジメントは、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーおよびその世界の関連会社の資産運用ビジネスのブランドです。J.P.モルガン・アセット・マネジメントは、総合的なサービスを提供するグローバル資産運用グループであり、1873年以来、多くの企業、金融機関、政府および個人に投資管理・助言サービスを提供しています。JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーは、「ダウ工業株30種平均」の構成銘柄です。

< 訂正後 >

ファンドは、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門であるJ.P.モルガン・アセット・マネジメントの一員である投資運用会社が運用いたします。

- J.P.モルガン・アセット・マネジメントの運用力・調査力を活用しています。
- グローバルに運用拠点を展開し、各拠点間で緊密な情報交換を行っています。
- グループ全体の債券の運用資産残高は8,225億米ドル(約101兆円)
(平成27年6月末日現在。WMロイター・レート(1米ドル122.37円)で換算)
※キャッシュ(マネーマーケット商品、手形、短期証券等)も含まれます。



(中略)

(注1)運用体制については、J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクを含めたJ.P.モルガン・アセット・マネジメントのものを記載しております。

(注2)上記の運用体制、組織名称等は、平成27年8月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

J.P.モルガン・アセット・マネジメントは、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーおよびその世界の関連会社の資産運用ビジネスのブランドです。J.P.モルガン・アセット・マネジメントは、総合的なサービスを提供するグローバル資産運用グループであり、1873年以来、多くの企業、金融機関、政府および個人に投資管理・助言サービスを提供しています。JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーは、「ダウ工業株30種平均」の構成銘柄です。

3 投資リスク

リスクに対する管理体制

< 訂正前 >

（前略）

- 投資方針、投資対象、投資制限等の遵守状況のチェック

上記の管理体制は平成27年5月末日現在のものであり、随時変更されます。

< 訂正後 >

（前略）

- 投資方針、投資対象、投資制限等の遵守状況のチェック

上記の管理体制は平成27年8月末日現在のものであり、随時変更されます。

4 手数料等及び税金

（5）課税上の取扱い

日本

< 訂正前 >

平成27年6月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

ファンドが税法上公募外国公社債投資信託である場合

（後略）

日本

< 訂正後 >

平成27年9月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

ファンドが税法上公募外国公社債投資信託である場合

（後略）

5 運用状況

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

< 訂正前 >

（前略）

< 優先株式 >

	銘柄	国・ 地域名	業種	株数	取得価額（円）		時価（円）		投資 比率 （％）
					単価	金額	単価	金額	
1	MORGAN STANLEY FRN PFD	米国	持株および金融会社	500,000	3,125	1,562,389,615	3,227	1,613,276,294	1.34

< 訂正後 >

（前略）

< 優先株式 >

	銘柄	国・ 地域名	業種	株数	取得価額（円）		時価（円）		投資 比率 （％）
					単価	金額	単価	金額	
1	MORGAN STANLEY FRN PFD	米国	持株および金融会社	500,000	3,125	1,562,389,615	3,227	1,613,276,294	1.34

< 参考情報 >

主要な資産の状況

組入上位10銘柄

(平成27年8月末日現在)

銘柄	国・地域名	種類	投資比率
			(%)
NATIONWIDE BLDG SOC FRN	イギリス	債券	4.10
KBC GROEP NV FRN	ベルギー	債券	4.08
WELLS FARGO AND CO FRN	米国	債券	3.33
LLOYDS BANKING GP FRN	イギリス	債券	3.16
CREDIT AGRICOLE SA FRN	フランス	債券	2.98
HSBC HOLDINGS PLC FRN	イギリス	債券	2.86
CITIGROUP INC FRN	米国	債券	2.84
BANCO BILBAO VIZC FRN	スペイン	債券	2.80
CREDIT SUISSE GROUP FRN	スイス	債券	2.43
GOLDMAN SACHS GROUP FRN	米国	債券	2.41

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

[次へ](#)

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

1 管理会社の概況

<訂正前>

（前略）

（2）管理会社の機構（平成27年5月末日現在）

管理会社はケイマン諸島において設立され、現在存続している免除会社です。同社の取締役会は、以下の1名の取締役に構成されます。

取締役	サイモン・エフ・ウォールス
-----	---------------

投資運用の意思決定は、投資運用会社であるJ.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクに委託されております。

<訂正後>

（前略）

（2）管理会社の機構（平成27年8月末日現在）

管理会社はケイマン諸島において設立され、現在存続している免除会社です。同社の取締役会は、以下の2名の取締役に構成されます。

取締役	サイモン・エフ・ウォールス
取締役	高橋 尚久

投資運用の意思決定は、投資運用会社であるJ.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクに委託されております。